

RENTABILIDADES DOS INVESTIMENTOS DO PLANO " BD " DO GASIU

2017

A - RENTABILIDADES DO ANO 2017 - Grupos de ativos

	metas rentabilidade	Ref	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUMULADO	
			real	real	real	real	real	real	real	real	real	real	real	real	real	real
Investimento Total	INPC + 0,39% ao mês	A	2,46%	3,15%	0,37%	-0,19%	-1,31%	0,29%	3,26%	2,00%	1,85%	-0,34%	-1,06%	1,44%	12,45%	6,97%
Renda Fixa	INPC + 0,39% ao mês	A	1,73%	3,51%	1,03%	-0,31%	-0,65%	0,22%	3,47%	1,30%	1,66%	-0,28%	-0,74%	0,76%	12,22%	6,97%
- Fundos Externos	102% do CDI ou IMA	B ou C	1,52%	2,32%	1,04%	0,17%	0,21%	0,08%	2,38%	1,08%	1,42%	-0,03%	-0,36%	0,40%	10,67%	10,13%
- Debentures	INPC + 0,39% ao mês	A	1,27%	1,03%	1,28%	0,98%	0,95%	0,74%	1,08%	1,01%	0,60%	0,96%	0,72%	0,43%	11,63%	6,97%
- Títulos Públicos	INPC + 0,39% ao mês	A	1,79%	3,91%	1,02%	-0,47%	-0,91%	0,25%	3,80%	1,38%	1,74%	-0,37%	-0,85%	0,85%	12,66%	6,97%
Renda Variável	INPC + 0,75% ao mês	D	7,78%	3,84%	-2,68%	0,12%	-5,32%	0,71%	4,60%	7,15%	3,70%	-0,97%	-3,35%	5,41%	21,94%	11,64%
- Carteira Própria Ações	Ibovespa	E	8,96%	3,95%	-4,33%	-0,55%	-7,44%	0,43%	5,32%	9,06%	3,55%	-1,28%	-4,04%	5,65%	19,25%	26,86%
- Fundos Externos	Ibovespa	F	6,59%	3,72%	-0,95%	0,78%	-3,17%	0,99%	3,92%	5,27%	3,86%	-0,66%	-2,65%	5,17%	24,69%	26,86%
Invest Estruturado	INPC + 0,67% ao mês	G	2,37%	1,83%	1,21%	0,50%	-2,72%	0,65%	1,35%	0,86%	2,26%	0,56%	-0,05%	0,99%	10,17%	10,58%
Investimento Imobiliário	INPC + 0,41% ao mês	A	-0,41%	-0,93%	-0,14%	-0,58%	-0,32%	-0,38%	-0,40%	-0,38%	-0,37%	-0,40%	-0,40%	-0,38%	-4,98%	6,97%
Empréstimos a Participantes	INPC + 0,7% ao mês	A	1,05%	1,09%	1,43%	1,22%	1,32%	1,07%	1,21%	0,47%	1,15%	0,80%	0,91%	1,36%	13,89%	6,97%
Objetivo Atuarial	INPC + 0,39% ao mês	A	0,81%	0,63%	0,71%	0,47%	0,75%	0,09%	0,56%	0,36%	0,37%	0,76%	0,57%	0,65%	-	6,97%

(a) A taxa atuarial que constou nos relatórios mensais foi de 5,5% a.a. (0,4480% a.a.m.). No entanto pelo estudo de adequação de taxa para 2017, foi reduzido ao final do ano para 4,8% a.a. (0,3915% a.m.)

B - Valores das metas

Indicador	Ref	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUMULADO	
INPC + 0,39% ao mês	A	0,81%	0,63%	0,71%	0,47%	0,75%	0,09%	0,56%	0,36%	0,37%	0,76%	0,57%	0,65%	-	6,97%
102% do CDI	B	1,11%	0,88%	1,07%	0,80%	0,94%	0,82%	0,81%	0,82%	0,65%	0,66%	0,58%	0,55%	-	10,13%
104,5% do CDI	H	1,13%	0,90%	1,10%	0,82%	0,97%	0,84%	0,83%	0,84%	0,67%	0,67%	0,59%	0,56%	-	10,39%
115% do CDI *	J	1,25%	0,99%	1,21%	0,90%	1,06%	0,93%	0,92%	0,92%	0,73%	0,74%	0,65%	0,62%	-	11,49%
IMA B	I	1,87%	3,85%	1,04%	-0,32%	-1,19%	0,16%	4,00%	1,34%	1,81%	-0,38%	-0,76%	0,83%	-	12,79%
IMA B 5+	C	2,24%	5,06%	0,88%	-0,82%	-1,78%	-0,06%	4,67%	1,36%	2,40%	-1,01%	-1,40%	0,79%	-	12,75%
INPC + 0,75% ao mês	D	1,17%	0,99%	1,07%	0,83%	1,11%	0,45%	0,92%	0,72%	0,73%	1,12%	0,93%	1,01%	-	11,64%
Ibovespa	E	7,38%	3,08%	-2,52%	0,64%	-4,12%	0,30%	4,80%	7,46%	4,88%	0,02%	-3,15%	6,16%	-	26,86%
Ibovespa	F	7,38%	3,08%	-2,52%	0,64%	-4,12%	0,30%	4,80%	7,46%	4,88%	0,02%	-3,15%	6,16%	-	26,86%
INPC + 0,67% ao mês	G	1,09%	0,91%	0,99%	0,75%	1,03%	0,37%	0,84%	0,64%	0,65%	1,04%	0,85%	0,93%	-	10,58%

* Nossa meta interna devido a elevada taxa de performance e prazo de resgate elevado

0,75% a.m. = 9,38% a.a.

0,67% a.m. = 8,31% a.a.

C - Variações reais dos indicadores em 2017

Indicador	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUMULADO	
INPC	0,42%	0,24%	0,32%	0,08%	0,36%	-0,30%	0,17%	-0,03%	-0,02%	0,37%	0,18%	0,26%	-	2,07%
CDI	1,08%	0,86%	1,05%	0,79%	0,93%	0,81%	0,80%	0,80%	0,64%	0,64%	0,57%	0,54%	-	9,93%
IMA B	1,87%	3,85%	1,04%	-0,32%	-1,19%	0,16%	4,00%	1,34%	1,81%	-0,38%	-0,76%	0,83%	-	12,79%
IMA B 5+	2,24%	5,06%	0,88%	-0,82%	-1,78%	-0,06%	4,67%	1,36%	2,40%	-1,01%	-1,40%	0,79%	-	12,75%
Ibovespa de Fechamento	7,38%	3,08%	-2,52%	0,64%	-4,12%	0,30%	4,80%	7,46%	4,88%	0,02%	-3,15%	6,16%	-	26,86%
Taxa Atuarial Real (a)	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	0,39%	-	4,80%

RENTABILIDADES DOS INVESTIMENTOS DO PLANO " BD " DO GASIU

2017

D - RENTABILIDADES REAIS DO ANO 2017 - Fundos Externos

2017

Fundos Renda Fixa			JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUMULADO	
			real	real	real	real	real	real	real	real	real	real	real	real	real	real
1 - DI Executive - HSBC	102% do CDI	B	1,10%	0,90%	1,06%	0,79%	0,93%	0,84%	0,81%	0,92%	0,69%	0,00%	0,00%	0,00%	8,33%	10,13%
4 - Sul América Multim Instituc	102% do CDI	B	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x
6 - ITAÚ Instituc Active Fix IB	102% do CDI	B	1,07%	0,92%	1,08%	0,78%	0,78%	0,82%	0,82%	0,84%	0,68%	0,60%	0,53%	0,55%	9,89%	10,13%
8 - Rio Bravo C P	102% do CDI		1,15%	0,91%	1,10%	0,75%	1,00%	0,99%	0,84%	0,80%	0,64%	0,64%	0,58%	0,54%	10,41%	10,13%
9 - BTG Pactual Emis Prim I	102% do CDI	B	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x
10 - BTG Pactual Emis Prim II	102% do CDI	B	1,30%	1,04%	0,29%	0,77%	0,28%	-57,00%	0,99%	1,38%	0,00%	1,32%	0,55%	-59,27%	-81,05%	10,13%
11 - Bradesco FIF Premium DI	102% do CDI	B	1,09%	0,87%	1,05%	0,91%	0,93%	0,83%	0,81%	0,99%	0,67%	0,00%	0,00%	0,00%	8,46%	10,13%
12 - ICATU Vang IPC Gold	IMA B 5+	C	2,24%	5,09%	0,87%	-0,86%	-1,83%	-0,13%	4,68%	1,34%	2,39%	-1,06%	-1,43%	0,80%	12,49%	12,75%
13 - HSBC Credito Privado	104,5% do CDI	H	1,15%	0,93%	1,10%	0,81%	0,95%	0,83%	0,83%	0,90%	0,69%	0,67%	0,57%	0,57%	10,49%	10,39%
14 - ITAU Renda Fixa IMAB5+	IMA B 5+	C	2,19%	5,01%	0,83%	-0,85%	-1,87%	-0,09%	4,63%	1,32%	2,36%	-1,04%	-1,43%	0,75%	12,16%	12,75%
15 - Sul América Inflate	IMA B	I	1,84%	3,88%	1,24%	-0,62%	0,17%	0,52%	3,97%	1,61%	1,87%	-0,19%	-1,14%	0,61%	14,51%	12,79%
16 - Sant Master RF CP LP	102% do CDI		1,14%	0,92%	1,09%	0,81%	0,96%	0,86%	0,81%	0,88%	0,67%	0,67%	0,57%	0,55%	10,39%	10,13%

Fundos Renda Variável

1 - ITAÚ RPI Ações (Ibovpa)	Ibovespa		7,26%	3,50%	-1,86%	1,18%	-4,09%	0,87%	4,89%	6,69%	4,93%	-0,85%	-3,54%	5,79%	26,70%	26,86%
2 - HSBC FICA Reg Prev (Ibovpa)	Ibovespa		7,90%	3,06%	-2,26%	0,27%	-3,08%	-0,14%	4,39%	5,76%	4,39%	-0,66%	-3,83%	5,68%	22,73%	26,86%
3 - ICATU Vanguarda Divid	Ibovespa		3,63%	2,61%	0,90%	0,41%	-1,10%	2,07%	2,31%	3,60%	2,65%	-0,73%	-0,77%	4,01%	21,23%	26,86%
4 - BRADESCO FIA Divid	Ibovespa		15,92%	1,53%	-1,72%	0,84%	-5,35%	0,74%	4,85%	5,83%	3,76%	-0,37%	-3,02%	5,77%	30,86%	26,86%
5 - RIO BRAVO Fund Inst (Valor)	Ibovespa (a)		2,99%	3,54%	0,37%	2,40%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	9,60%	26,86%
6 - ITAU FOF RPI 30 (Ibovespa)	Ibovespa		6,91%	3,32%	-1,35%	1,51%	-4,19%	0,59%	4,81%	6,20%	5,14%	-0,56%	-3,80%	5,60%	26,03%	26,86%

(a) Fundo encerrado em maio 2017

Fundos Estruturados

1-Santander Capital Protegido	INPC + 0,54% ao mês		x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x
2 - Itau Hedge MM FI	115% do CDI		1,85%	1,44%	1,12%	0,59%	-1,40%	0,67%	1,08%	0,82%	2,14%	0,38%	0,38%	0,52%	9,97%	11,49%
3 - RT Hedge Plus MM ITAU FIC	115% do CDI		2,76%	2,13%	1,32%	0,48%	-3,54%	0,69%	1,56%	0,94%	3,93%	0,18%	0,25%	0,55%	11,65%	11,49%
4 - Itau Retorno Absoluto	115% do CDI		x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x	x
5 - Galileo Institucional FIC FIM	115% do CDI										-0,03%	1,40%	-0,86%	2,22%	2,73%	2,27%

(a) alterado em setembro de ITAU FOF RPI (valor), para ITAU FOF RPI 30 Ações Ibovespa

fonte : Área de Investimentos do Gasius

configuração Impressão

0,3 / 0,3 / 1,5 / 0,5 - paisagem - 100%

data: 11/01/2018

Hoje: 16/02/2018